



Trusted archives for scholarship

- [Login](#)
- [Help](#)
- [Contact Us](#)

Update on
System

Browse

About

Participate

Resources

JSTOR

of the JSTOR

Your access to JSTOR provided by United States Patent and
Trademark Office

Basic Search Article Locator

Search

[Search](#)
[Help](#)

 - OR -

☐ search within these
results

- Articles
- Images in JSTOR
- Images in ARTstor

Results 1-25 of 1278 for << ((proxy portfolio) AND (sensitivity analysis)) >>

 Sort by
 Display:

Page 1 of 52 < Previous | Next

Go to page
☐ Select/ unselect all

☐ Save citation(s) (Requires login)

☐ 1.

- Sensitivity Analysis for Mean-Variance Portfolio Problems
- Michael J. Best, Robert R. Grauer
- Management Science, Vol. 37, No. 8 (Aug., 1991), pp. 980-989
- Article Information
- Page of First
- Match PDF
- Export this Citation

☐ 2.

- Messaging Mean-Variance Inputs: Returns from Alternative Global Investment
- Vijay K. Chopra, Chris R. Hensel, Andrew L. Turner
- Management Science, Vol. 39, No. 7 (Jul., 1993), pp. 845-855
- Article Information
- Page of First
- Match PDF
- Export this Citation

- ☐ 3. [Strategies in the 1980s](#)
- [Inducing Stock Screening Rules for Portfolio Construction](#) ◦ [Kai Yan Tam, Melody Y. Kiang, Robert I. H. Chi](#) [The Journal of the Operational Research Society, Vol. 42, No. 9 \(Sep., 1991\), pp. 747-757](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 4.
- [Systemic Risk and International Portfolio Choice](#) ◦ [Sanjit Bhanu Das, Ramani Uppal](#) [The Journal of Finance, Vol. 59, No. 6 \(Dec., 2004\), pp. 2809-2834](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 5.
- [Diversification as a Public Good: Community Effects in Portfolio Choice](#) ◦ [Peter M. Demarzo, Ron Kanai, Han Kremer](#) [The Journal of Finance, Vol. 59, No. 4 \(Aug., 2004\), pp. 1677-1715](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 6.
- [Bayesian Inference and Portfolio Efficiency](#) ◦ [Shmuel Kandel, Robert McCulloch, Robert F. Stambaugh](#) [The Review of Financial Studies, Vol. 8, No. 1 \(Spring, 1995\), pp. 1-53](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 7.
- [Abnormal Returns to a Fundamental Analysis Strategy](#) ◦ [Jeffery S. Abartenelli, Brian J. Bushee](#) [The Accounting Review, Vol. 73, No. 1 \(Jan., 1998\), pp. 19-45](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 8.
- [Life Insurance Company Portfolio Behavior](#) ◦ [John G. Stowe](#) [The Journal of Risk and Insurance, Vol. 45, No. 3 \(Sep., 1978\), pp. 431-447](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 9.
- [Option Portfolio Strategies: Measurement and Evaluation](#) ◦ [Richard Bookstaber, Roger Clarke](#) [The Journal of Business, Vol. 57, No. 4 \(Oct., 1984\), pp. 469-492](#) ◦ [Article Information](#) ◦ [Page of First](#) ◦ [Match PDF](#) ◦ [Export this](#) ◦ [Citation](#)
- ☐ 10.

- ☐ 11. [Portfolio Insurance and Financial Market Equilibrium](#) [Michael J. Brennan](#), [Eduardo S. Schwartz](#), *The Journal of Business*, Vol. 62, No. 4 (Oct., 1989), pp. 455-472 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ 12. [Portfolio Selection and Asset Pricing Models](#) [Ľuboš Pastor](#), *The Journal of Finance*, Vol. 55, No. 1 (Feb., 2000), pp. 179-223 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ 13. [Portfolio Choice in the Presence of Background Risk](#) [John Heaton](#), *The Economic Journal*, Vol. 110, No. 460 (Jan., 2000), pp. 1-26 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ 14. [A Comparison of Single and Multifactor Portfolio Performance Methodologies](#) [Nai-Fu Chen](#), [Thomas E. Copeland](#), [David Mayers](#), *The Journal of Financial and Quantitative Analysis*, Vol. 22, No. 4 (Dec., 1987), pp. 401-417 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ 15. [On Portfolio Optimization: Forecasting Covariances and Choosing the Risk Model](#) [Jason Karceski](#), [Josef Lakonishok](#), [Louis K. C. Chan](#), *The Review of Financial Studies*, Vol. 12, No. 5 (Winter, 1999), pp. 937-974 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ 16. [Asset Pricing Models: Implications for Expected Returns and Portfolio Selection](#) [A. Craig MacKinlay](#), [Ľuboš Pastor](#), *The Review of Financial Studies*, Vol. 13, No. 4 (Winter, 2000), pp. 883-916 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ 17. [Interest Rate Sensitivity and Portfolio Risk](#) [John G. Martin](#), [Arthur J. Keown](#), *The Journal of Financial and Quantitative Analysis*, Vol. 12, No. 2 (Jun., 1977), pp. 181-195 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)
- ☐ [Income Risk](#) [Luigi Guiso](#), *The* [Article](#)

Borrowing Constraints and Portfolio Choice Tullio Jappelli, Daniele Terlizzese American Economic Review, Vol. 86, No. 1 (Mar., 1996), pp. 158-172 [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)

18.

◦ A Test of the Efficiency of a Given Portfolio Michael S. Gibbons, Stephen A. Ross, Jay Shanken Econometrica, Vol. 57, No. 5 (Sep., 1989), pp. 1121-1152 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)

19.

◦ Cash and Corporate Control Obumnio Fajana The Journal of Finance, Vol. 59, No. 5 (Oct., 2004), pp. 2041-2060 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)

20.

◦ Equilibrium Mispricing in a Capital Market with Portfolio Constraints Suleyman Basak, Benjamin C. Croux The Review of Financial Studies, Vol. 13, No. 3 (Autumn, 2000), pp. 715-748 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)

21.

◦ What is the Opportunity Cost of Mean-Variance Investment Strategies? Yusuf Simaan Management Science, Vol. 39, No. 5 (May, 1993), pp. 578-587 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)

22.

◦ The Effect of Mandated Market Risk Disclosures on Trading Volume: Sensitivity to Interest Rate Exchange Rate, and Commodity Price Movements Thomas J. Linsmeier, Daniel B. Thornton, Mohan Venkateshram, Michael Walker The Accounting Review, Vol. 77, No. 2 (Apr., 2002), pp. 343-377 [Article](#) [Information](#) [Page of First](#) [Match PDF](#) [Export this](#) [Citation](#)

23.

◦ On the Sensitivity of Mean-Variance Michael J. Best, Robert The Review of Financial Studies, [Article](#) [Information](#) [Page of First](#)

[Efficient](#) [R](#) [Vol. 4,](#) [Match PDF](#)
[Portfolios to](#) [Grawer](#) [No. 2](#) [Export this](#)
[Changes in](#) [\(1991\),](#) [Citation](#)
[Asset Means:](#) [pp. 315-](#)
[Some Analytical](#) [342](#)
[and](#)
[Computational](#)
☐ 24. [Results](#)

☐ Commercial: [Arie](#) [The](#) [Article](#)
[Bank Portfolio](#) [Meinik](#) [Journal of](#) [Information](#)
[Behavior: An](#) [Finance,](#) [Page of First](#)
[Empirical](#) [Vol. 24,](#) [Match PDF](#)
[Analysis](#) [No. 5](#) [Export this](#)
[\(Dec.,](#) [Citation](#)
[1969\),](#)
☐ 25. [pp. 965-](#)
[966](#)

☐ [Stratport: A](#) [Jean-Claude](#) [Management](#) [Article](#)
[Model for the](#) [Laroché, Y](#) [Science, Vol.](#) [Information](#)
[Evaluation](#) [Srinivasan](#) [28, No. 9](#) [Page of First](#)
[and](#) [\(Sep., 1982\),](#) [Match PDF](#)
[Formulation](#) [pp. 979-1001](#) [Export this](#)
[of Business](#) [Citation](#)
[Portfolio](#)
[Strategies](#)

[Previous](#) | [Next](#)

Go to page



JSTOR is a not-for-profit organization that serves and is supported by the scholarly community.

[Terms and Conditions](#) | [Privacy Policy](#) | [Accessibility](#)

© 2006-2008 JSTOR All Rights Reserved. JSTOR® and the JSTOR logo are registered trademarks.

Your access to JSTOR provided by
United States Patent and Trademark Office